

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh faktor fundamental yang diukur dengan *Return On Equity* (ROE), *Earning Per Share* (EPS), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Price Earning Ratio* (PER), dan *Price to Book Value* (PBV) dan Risiko Sistematis yang diukur dengan *Beta* saham terhadap Harga Saham. Teknik pemilihan sampel menggunakan metode *purposive sampling* dan diperoleh 7 perusahaan konstruksi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2012-2016. Teknik analisis menggunakan analisis regresi linear berganda.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa *Return On Equity* (ROE) memiliki pengaruh negatif dan signifikan terhadap harga saham yang dibuktikan dengan tingkat signifikansi 0,008. *Earning Per Share* (EPS) memiliki pengaruh positif dan signifikan terhadap harga saham yang dibuktikan dengan tingkat signifikansi 0,000. *Debt to Equity Ratio* (DER) memiliki pengaruh positif dan tidak signifikan terhadap harga saham yang dibuktikan dengan tingkat signifikansi 0,326. *Price Earning Ratio* (PER) memiliki pengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap harga saham yang dibuktikan dengan tingkat signifikansi 0,207. *Price to Book Value* (PBV) memiliki pengaruh positif dan signifikan terhadap harga saham yang dibuktikan dengan tingkat signifikansi 0,000. Risiko Sistematis memiliki pengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap harga saham yang dibuktikan dengan tingkat signifikansi 0,099. Hasil koefisien determinasi sebesar 0,879 menunjukkan bahwa kemampuan variabel bebas dalam menjelaskan variabel terikat adalah sebesar 87,9% dan sisanya sebesar 12,1% dijelaskan oleh variabel lain di luar model penelitian.

Kata kunci : *Return On Equity*, *Earning Per Share*, *Debt to Equity Ratio*, *Price Earning Ratio*, *Price to Book Value*, Risiko Sistematis dan harga saham.

ABSTRACT

This research aims to determine the influence of fundamental factors measured by Return On Equity (ROE), Earning Per Share (EPS), Debt to Equity Ratio (DER), Price Earning Ratio (PER), and Price to Book Value (PBV) and Risk Systematic as measured by stock Beta against the Stock Price. The sample selection technique that been used purposive sampling method and obtained 7 construction companies which is listed in Indonesia Stock Exchange 2012-2016. The analysis technique that used multiple linear regression analysis.

The results showed that Return On Equity (ROE) has a negative and significant influence on stock prices as evidenced by a significance level of 0.008. Earning Per Share (EPS) has a positive and significant influence on stock prices as evidenced by a 0.000 significance level. Debt to Equity Ratio (DER) has a positive and insignificant influence on the stock prices that is evidenced by a significance level of 0.326. Price Earning Ratio (PER) has a negative and insignificant influence on the stock price as evidenced by the level of significance of 0.207. Price to Book Value (PBV) has a positive and significant influence on stock prices as evidenced by a 0.000 significance level. Systematic risk has a negative and not significant influence on the stock prices as evidenced by the 0.099 significance level. The result of determination coefficient of 0.879 shows that the ability of independent variable in explaining the dependent variable is 87,9% and the rest equal to 12,1% explained by other variable outside research model.

Keywords: Return on equity, earning per share, debt to equity ratio, price earning ratio, price to book value, systematic risk and share price.

Nama Mahasiswa

NPM

Tanggal Masuk

Tanggal Selesai

Abstrak ini adalah memang betul translasi dari LAPORAN BAHASA
Sebelum dengan adanya yang telah disetujui oleh dosen pembimbing



Pembaca LAPORAN BAHASA